

Cadenas de Markov en Tiempo Discreto
Cadenas de Markov Absorventes

CMTD-abs: $\exists p_{ii} = 1$, ji-com

1. $P = ((Q, 0), (R, I)) \rightarrow P^n = ((Q^n, 0), (*, I))$
2. CMTD-abs $\rightarrow \lim_{n \rightarrow \infty} Q^n = 0$
3. $N = I + Q + Q^2 + \dots$, matriz fundamental $N = (I - Q)^{-1}$
4. $T = Ne = ()(I - Q)^{-1}e$, $A = NR = (I - Q)^{-1}R$

References

- [1] Ríos-Insua, S., Mateos-Caballero, A., Bielza, C., Jimenez-Martín, A. (2004), Investigación Operativa. Modelos determinísticos y estocásticos Editorial Centro de Estudios Ramón Areces, S.A.